

Analisa pola harga komoditi untuk kegiatan future trading di bursa komoditi : suatu pendekatan analisa teknis dan penerapan model pramalan Arima

Meiyanne Diah P. Saad, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20184087&lokasi=lokal>

Abstrak

Kegiatan Future Trading mempunyai dua fungsi, yaitu sebagai sarana lindung nilai (hedging) dan sebagai salah satu bentuk investasi. Dalam pengambilan keputusan pada kegiatan ini seorang peserta pasar, baik sebagai, hedger maupun sebagai investor, harus memperhatikan pergerakan harga yang terjadi, karena fluktuasi harga cukup tinggi. Tujuan penelitian ini adalah menganalisa dan meramal pola pergerakan harga komoditi yang akan datang berdasarkan pendekatan teknis, dimana variabel yang dianggap relevan adalah data historis dari harga komoditi tersebut. Dimana seorang teknisi percaya bahwa pergerakan harga di pasar merupakan pola-pola pengulangan yang pernah terjadi di masa sebelumnya. Sehingga dengan menganalisa dan mengidentifikasi pola-pola secara tepat maka dengan mudah dapat diambil keputusan yang sesuai, dengan harapan bahwa pola tersebut akan terrealisir di kemudian waktu. Metode penelitian yang digunakan adalah metode kepustakaan dan penelitian lapangan untuk pengumpulan dan analisa data. Komoditi yang dianalisa adalah Soybean, Rubber, dan Cotton, yang merupakan major commodities. Hasil penelitian yang dilakukan dengan pendekatan analisa teknis menunjukkan bahwa harga ketiga komoditi menunjukkan suatu trend yang menurun, dan ketika dikonfirmasi dengan model peramalan ARIMA dengan metode" Box - Jenkins diperoleh hasil yang sama. Kesimpulan dari proses analisa gabungan di atas, adalah bahwa prakiraan harga komoditi dengan menggunakan metode tersebut memberikan hasil yang cukup baik dan cukup informatif bagi pengambilan keputusan mengenai penentuan posisi perdagangan. Saran dari hasil penelitian antara lain dalam melakukan analisa sebaiknya data deret berkala mempunyai dimensi waktu dan periode yang berlainan~ untuk tidak menggunakan hasil prakiraan yang terlalu jauh~ untuk selalu menambah data harga baru yang terakhir muncul~ dan disarankan agar selalu mengkaitkan proses di atas dengan metode" dan perangkat tambahan lainnya untuk memperoleh informasi yang lebih lengkap.